

東京短資デイリーレポート

2024/7/3

<7月2日のマネタリーベース>

6,744,500

<7月3日9時20分日銀オペ後の状況>

9時20分の日銀オペ	ノーオペ
日銀発表の日銀当座預金残高	5,468,100
前日の日銀当座預金残高①	5,510,000
日銀当座預金残高増減前日比	-41,900

<7月3日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給実績		
銀行券要因	-15,400	
財政等要因	-59,900	
資金過不足	-75,300	
金融調節		
	期落	新規
国債補完供給	+31,000	-25,800
金融調節合計		+5,200
当座預金増減②		-70,100

<7月3日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,439,900
準備預金残高	4,837,900
積み終了先	4,837,800
超過準備	4,837,800
非準備先残高	602,000

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,942,000
今積み期間所要準備額 (平均)	131,400
残り要積立額 (積数)	500
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率 (%)	99.9
日数進捗率 (%)	60.0
進捗率乖離幅	+39.9

<7月4日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給予想		
銀行券要因	-3,600	
財政等要因	+1,000	
資金過不足	-2,600	
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+10,800
国債補完供給	+25,800	
金融調節合計		+36,600
当座預金増減		+34,000

<7月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆3,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~-0.080% での合いが中心か。	
---	--

<7月4日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分の オペ	日銀当座 預金残高	前日比 増減
+45,000	5,518,900	+79,000
+40,000	5,513,900	+74,000
+35,000	5,508,900	+69,000
+30,000	5,503,900	+64,000
+25,000	5,498,900	+59,000
+20,000	5,493,900	+54,000
+15,000	5,488,900	+49,000
+10,000	5,483,900	+44,000
+5,000	5,478,900	+39,000
± 0	5,473,900	+34,000
-5,000	5,468,900	+29,000
-10,000	5,463,900	+24,000
-15,000	5,458,900	+19,000
-20,000	5,453,900	+14,000
-25,000	5,448,900	+9,000
-30,000	5,443,900	+4,000
-35,000	5,438,900	-1,000
-40,000	5,433,900	-6,000
-45,000	5,428,900	-11,000

<7月3日 日銀オペ入札結果>

※スペースの関係上、内容を省略する場合があります。詳細は弊社HPをご参照ください。

(10:10) 国債買入(-1Y)	24/ 7/ 4	1,500億 応札 4,262億 落札 1,500億 最低 -0.010% 平均 +0.005% 按分 0.1%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	24/ 7/ 4	3,750億 応札 11,320億 落札 3,754億 最低 -0.014% 平均 -0.010% 按分 19.2%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/ 7/ 4	4,250億 応札 8,045億 落札 4,255億 最低 -0.019% 平均 -0.015% 按分 84.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 7/ 4	1,500億 応札 3,908億 落札 1,504億 最低 +0.007% 平均 +0.010% 按分 67.6%
(11:50) 国債補完供給	24/ 7/ 3-24/ 7/ 4	応札 26,568億 落札 26,568億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補完供給	24/ 7/ 3-24/ 7/ 4	応札 0億 落札 0億

<7月3日 各オペ残高と内訳>

(カッコ内は先日付スタート・#印はエンドが13時同時処理)

共通担保(全店)固定金利	国債買入額(月初末)	貸出支援基金の運営として行方オペレーション	被災地金融機関支援資金供給							
9 9, 2 2 6	7, 1 1 0	成長基盤強化支援資金供給	1, 0 0 1							
6/26~ 7/10	8,005.	3 1, 5 2 3	8 6 8, 6 5 8							
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.							
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	7/ 1(10-25Y)	1,506.							
1/10~ 1/10	20,011.	7/ 1(25Y-)	752.							
1/13~ 1/14	20,008.	7/ 1(物国)	600.							
1/16~ 1/16	20,009.	(7/ 4(-1Y)	1,500.)							
1/19~ 1/20	1,163.	(7/ 4(1-3Y)	3,754.)							
		(7/ 4(3-5Y)	4,255.)							
		(7/ 4(10-25Y)	1,504.)							
※直近約1年分の期落ち分を記載										
成長基盤強化支援米ドル特別										
1 6, 1 2 2 百万ドル										
9/ 5~ 9/ 5				5,382.						
12/ 4~12/ 4				3,325.						
3/ 4~ 3/ 4				2,097.						
6/ 3~ 6/ 3				5,318.						
国債買現先オペ										
0										
国債売現先(米ドルオペ用担保)										
0										
国庫短期証券買入額(月初末)										
0										
国債売現先オペ										
0										
C P 買入額(月初末)										
0										
ETF買入額										
3 5 6, 9 2 1										
約定 23/10/ 4				701.						
ETF買入額(企業支援)										
1 4, 6 2 8										
約定 21/ 3/31				12.						
J-REIT買入額										
6, 8 2 3										
約定 22/ 6/14				12.						
※直近約1週間の実施分を記載										
被災地金融機関支援										
1, 0 0 1										
気候変動対応支援										
81, 6 6 3										
成長基盤支援				27, 0 7 6						
手形売出				0						
貸出増加支援				790, 6 4 6						
国債売現先				0						
供給オペ合計				1, 0 6 9, 6 4 7						
国債補完供給				26, 5 6 8						
貸出(推定)				0						
国売現(米ドル担保)				0						
供給額合計				1, 0 6 9, 6 4 7						
吸収額合計				26, 5 6 8						
差し引き				1, 0 4 3, 0 7 9						
※成長基盤強化支援資金供給の各オペは、貸付日・返済期日が同じ場合まとめて表示しています。										
ETF・J-REIT買入は、買入総額と直近の買入を表示しています。 共通担保・成長基盤強化支援・貸出増加支援の各資金供給オペの貸付残高は、期日前返済による減少があるため、貸付額の合計とは必ずしも一致しません。										
<7月3日のオープン市場気配レート(単位:%)>										
NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト						
S/N	+0.070	1M	+0.170000	3M	買気配 +0.050					
1W	売気配 +0.070	2M	+0.140000	6M	買気配 +0.150					
2W	売気配 +0.070	3M	-----	1Y	買気配 +0.150					
1M	売気配 +0.070									
<7月3日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>										
無担保コール				有担保コール				東京レポレート		
	最低	最高	平均	前日比	最低	最高	平均	前日比	平均値	前日比
翌日物	0.050	0.078	0.077	± 0					0.047	-0.031
トムネ				-----					0.051	-0.028
スポネ				-----						
1週間物	0.240	0.250	0.248	+0.123					0.051	-0.003
2週間物				-----					0.051	± 0
3週間物				-----					0.051	± 0
1ヶ月物				-----					0.051	± 0
3ヶ月物				-----					0.084	± 0
6ヶ月物				-----					0.139	± 0
1年物				-----					0.200	± 0

<7月2日のコール市場残高(単位:億円)>

残高			増減		
市場合計	115,583		+35		
有担保	38,235		+175		
無担保	77,348		-140		

本資料は情報提供を目的としてのみ作成されたものであり、お取引の最終決定は御自身の判断でなされますようお願いいたします。
本資料に記載されている内容は、信頼できる情報源に基づき作成されたものですが、弊社はその正確性および現実性を保証するものではありません。
非上場債券(国債、CP等)を当社が相手方となりお買付けいただく場合は、購入対価のみお支払いいただきます。
債券は、金利水準の変化等により価格が上下し、損失が生じるおそれがあります。
商号等：東京短資株式会社 登録金融機関 関東財務局(登金)第524号 加入協会：日本証券業協会